

Fecha de Publicación: 1 de julio de 2014

Fecha de Información: 26 de junio de 2014 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1237,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,5	73,9	33,3	63,1	22,6	32,4	18,0
15-35	367,2	582,7	307,2	142,0	115,0	64,7	160,5
36-60	2,9	32,2	0,0	0,0	32,2	2,9	0,0
61-90	24,1	7,8	0,0	0,0	7,8	24,1	0,0
91-180	82,0	81,1	38,0	0,0	13,1	52,0	30,0
>180	51,6	56,8	10,0	10,0	16,8	11,6	30,0
Total	641,3	834,4	388,5	215,1	207,4	187,7	238,5

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,7 %	2,6 %	1,1 %	1,9 %
15-35	1,0 %	1,9 %	0,2 %	1,3 %
36-60	-	3,0 %	1,3 %	2,8 %
61-90	-	3,7 %	2,2 %	2,6 %
91-180	2,1 %	4,2 %	1,5 %	2,1 %
>180	3,6 %	4,0 %	3,1 %	3,6 %
Total	1,5 %	2,2 %	1,0 %	1,7 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards**

Sector	23 al 27 de junio				30 de jun. al 4 de julio				7 al 11 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	87	3081	3302	7	68	1455	1885	10	67	1828	2045
Intragruppo y off-shore***	0	0	1663	1368	0	0	1094	333	0	0	1097	704
Otros	87	25	816	891	68	7	250	582	67	10	383	558
Total	112	112	5561	5561	75	75	2800	2800	77	77	3308	3308

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.